

9-01 KELER KSZF leirat

Áthárított ECC garanciaalap küszöbértéke

Hatálybalépés dátuma: 2022. szeptember 15.

A KELER KSZF Zrt. Általános Üzletszabályzat IX. fejezete szerinti áthárított ECC garanciaalapra vonatkozó rendelkezéseit az alábbiak szerint határozza meg.

Küszöbérték

A küszöbérték: 0 EUR, azaz a teljes ECC garanciaalap áthárításra kerül.

Kockázatarányos felosztás

A KELER KSZF Általános Üzletszabályzata szerinti kockázatarányos felosztás során a KELER KSZF az ECC által megadott és az ECC által alkalmazott garanciaalap meghatározási gyakorlat alapján az arányosság elvének érvényesülése érdekében a következők szerint jár el.

1. számítási módszer

A felosztás vetítési alapja az ECC által egy adott energiapiaci alklíringtagra meghatározott egyéni biztosítékok összesített értékének (azaz számított egyéni kockázat) és a KELER KSZF által elszámolt valamennyi energiapiaci alklíringtagra az ECC által meghatározott összesített egyéni biztosítékának (azaz összesített kockázat) hányadosa:

$$\text{Egyéni hozzájárulás (\%)} = \frac{\text{ECC által meghatározott egyéni számított kockázat}}{\text{ECC által meghatározott összes egyéni számított kockázat}}$$

2. számítási módszer

A felosztás vetítési alapja az ECC által megadott, a garanciaalap számítás során kockázati kitettséget eredményező energiapiaci alklíringtagra meghatározott többlet egyéni biztosíték (azaz számított egyéni kockázat) és az ECC által megadott, a garanciaalap számítás során kockázati kitettséget eredményező valamennyi energiapiaci alklíringtagra meghatározott többlet egyéni biztosíték összesített értékének (azaz összesített kockázat) hányadosa.

$$\text{Egyéni hozzájárulás (\%)} = \frac{\text{ECC által meghatározott egyéni számított kockázat}}{\text{ECC által meghatározott összes egyéni számított kockázat}}$$

Az egyéni hozzájárulás hányadosának meghatározása az ECC által megadott, és alkalmazott gyakorlat szerint, a számítás napján érvényes számított egyéni kockázat alapján történik.

Teljesítési határidő

A meghatározást követően a KELER KSZF elektronikus úton értesíti az energiapiaci alklíringtagokat az ECC által megadottak alapján a meghatározás során alkalmazott számítási módszerről valamint a teljesítendő áthárított garanciaalap hozzájárulás mértékéről, melynek teljesítési határideje a meghatározást követő elszámolási nap 10:00 óra. A teljesítendő összeget a KELER KSZF a napi

biztosítékrendezéssel azonos módon és időben elvonja az energiapiaci alklíringtag számlájáról.

ECC általi garanciaalap lehívás és visszatöltési kötelezettség elrendelése esetén az energiapiaci alklíringtagokra vonatkozó teljesítési határidő a meghatározást követő tízedik (10.) elszámolási nap 10:00 óra. Az áthárított garanciaalap teljesítési kötelezettség késedelme vagy elmulasztása esetén a KELER KSZF az Általános Üzletszabályzat nemteljesítésekre vonatkozó szabályai szerint jár el.

Amennyiben az energiapiaci alklíringtagok részére áthárított garanciaalap hozzájárulás korábbi küszöbértéket meghaladó szintről a küszöbérték szintje alá csökken, a KELER KSZF az áthárítás napján elrendelt felosztási arányoknak megfelelően beszedett hozzájárulást rendezi vissza az energiapiaci alklíringtagok számlájára a meghatározást követően elszámolási napon 10:00 óráig.

Példák a küszöbérték alkalmazására:

1. Példa: ECC garanciaalap igény 10 millió EUR

Az ECC által meghatározott aktuális garanciaalap igény mértéke 10.000.000 EUR, mely az energiapiaci alklíringtagok között kerül kockázatarányosan felosztásra.

Számítási példa a kockázatarányos felosztásra az 1. módszertan szerint:

1. Adott energiapiaci alklíringtag egyéni összesített ECC által meghatározott számított kockázata = 270.000 EUR.
2. A KELER KSZF összes energiapiaci alklíringtagjára ECC által meghatározott számított kockázat = 43.771.826,80 EUR.

Az adott energiapiaci alklíringtagra meghatározott egyéni hányados (négy tizedesjegyre kerekítve) = $270.000 / 43.771.826,80 = 0,6168\%$.

A hányados alapján az adott energiapiaci alklíringtag által teljesítendő áthárított ECC garanciaalap összege (egész számra kerekítve) = $10.000.000 \text{ EUR} \times 0,6168\% = 61.680 \text{ EUR}$.

Számítási példa a kockázatarányos felosztásra az 2. módszertan szerint:

1. Az ECC által megadott kockázati kitettséget eredményező energiapiaci alklíringtagra meghatározott többlet egyéni biztosíték = 4.200.000 EUR
2. Az ECC által megadott összes kockázati kitettséget eredményező energiapiaci alklíringtagra ECC által meghatározott számított kockázat = 10.000.000,00 EUR.

Az adott energiapiaci alklíringtagra meghatározott egyéni hányados (kettő tizedesjegyre kerekítve) = $4.200.000 / 10.000.000,00 = 42,00\%$.

A hányados alapján az adott energiapiaci alklíringtag által teljesítendő áthárított ECC garanciaalap összege (egész számra kerekítve) = $10.000.000 \text{ EUR} \times 42,00\% = 4.200.000 \text{ EUR}$.

2. Példa: ECC általi garanciaalap lehívás és visszatöltés nemteljesítés következtében

Az ECC Klíring szabályzata alapján egy vagy több klíringtag nemteljesítése esetén az ECC jogosult felhasználni a garanciaalapot. A garanciaalap felhasználása esetén az ECC újraszámítja a garanciaalapot és elrendeli a visszatöltést az eredeti (felhasználás előtti) hozzájárulás mértékéig. Ebben az esetben a KELER KSZF a lehívás előtti garanciaalap hozzájárulás mértékének függvényében jogosult áthárítani az újbóli garanciaalap hozzájárulást, és az aktuálisan alkalmazott módszertanhoz tartozó 1. vagy 2. példa szerinti elvvel azonos módon kerül meghatározásra az energiapiaci alklíringtagok hozzájárulási kötelezettsége.

Budapest, 2022. szeptember 15.

KELER KSZF Zrt.